

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	1999年7月23日から無期限です。	
運用方針	アムンディ・日経225オープンマザーファンドの受益証券への投資を通じて、日経平均トータルリターン・インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	りそな・日経225オープン	アムンディ・日経225オープンマザーファンドの受益証券
	アムンディ・日経225オープンマザーファンド	東京証券取引所プライム市場に上場されている株式
組入制限	りそな・日経225オープン	株式の実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	アムンディ・日経225オープンマザーファンド	株式の投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時（年1回、原則毎年7月11日。休業日の場合は翌営業日）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入および売買益等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

りそな・日経225オープン

運用報告書（全体版）

第25期（決算日 2024年7月11日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン：050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス：<https://www.amundi.co.jp/>

< 3733296・3778517 >

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均トータルリターン・インデックス (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
21期(2020年7月13日)	14,946	0	6.7	37,360.58	7.5	97.8	2.1	32,344
22期(2021年7月12日)	18,875	0	26.3	47,599.55	27.4	97.5	2.4	31,828
23期(2022年7月11日)	17,904	0	△ 5.1	45,555.95	△ 4.3	96.7	3.2	29,872
24期(2023年7月11日)	21,816	0	21.8	55,957.81	22.8	97.6	2.4	26,243
25期(2024年7月11日)	28,884	0	32.4	74,730.72	33.5	98.0	1.9	31,129

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」「株式先物比率」は実質組入比率を記載しています。以下同じ。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。以下同じ。

(注3) ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。日経平均トータルリターン・インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均トータルリターン・インデックスを継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。またファンドの運用およびファンドの受益権の取引に関して、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

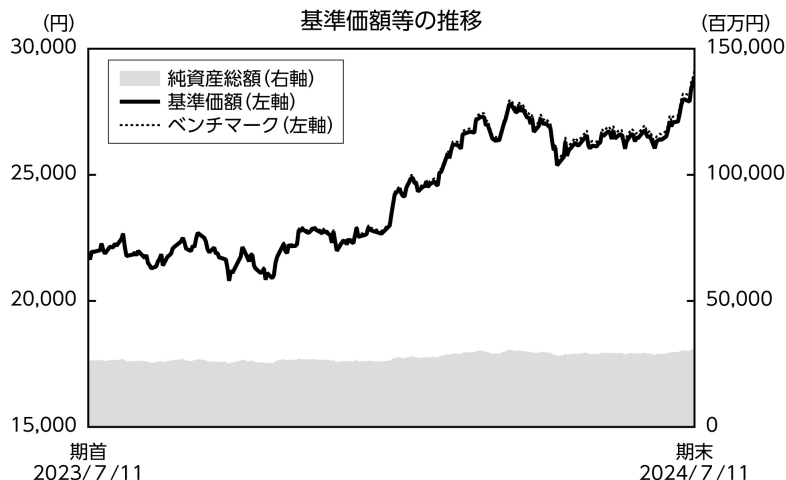
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		日経平均トータルリターン・インデックス (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%	円	%	%	%
2023年7月11日	21,816	—	55,957.81	—	97.6	2.4
7月末	22,464	3.0	57,645.38	3.0	98.1	1.9
8月末	22,085	1.2	56,720.29	1.4	97.2	2.8
9月末	21,706	△ 0.5	55,787.13	△ 0.3	96.3	3.5
10月末	21,010	△ 3.7	54,040.84	△ 3.4	96.0	4.0
11月末	22,786	4.4	58,651.09	4.8	97.1	2.8
12月末	22,792	4.5	58,704.41	4.9	99.0	1.0
2024年1月末	24,699	13.2	63,659.32	13.8	98.6	1.4
2月末	26,664	22.2	68,747.00	22.9	97.4	2.6
3月末	27,645	26.7	71,346.41	27.5	96.8	3.2
4月末	26,283	20.5	67,877.75	21.3	94.7	5.3
5月末	26,327	20.7	68,023.40	21.6	97.8	2.1
6月末	27,084	24.1	70,056.40	25.2	98.5	1.5
(期末)						
2024年7月11日	28,884	32.4	74,730.72	33.5	98.0	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第25期首	21,816円
第25期末	28,884円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	32.4%



(注1) ベンチマーク（ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数）は、日経平均トータルリターン・インデックスです。

(注2) ベンチマークは、2023年7月11日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 米国雇用統計の内容が弱かったことから利上げ観測が後退したこと（2023年11月）
- ② 東京証券取引所の要請に基づく企業のガバナンス改革への期待の高まりや、外国人投資家の買い、生成A I（人工知能）関連需要への期待が高まったこと（2024年1月～3月上旬）
- ③ 円安が進行したことで輸出関連企業の決算への期待が高まったこと（2024年6月～7月）

下落要因

- ① 中東情勢の緊迫化や米国で追加利上げに対する懸念が広がったこと（2023年9月～10月）
- ② 年度末を控えた機関投資家の利益確定売りに押されたことや、米国の利下げ期待が後退し上値が重くなった米国株の影響を受けたこと（2024年3月下旬～4月）

【投資環境】

投資環境につきましては、主要投資対象であるアムンディ・日経225オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ポートフォリオ】**<当ファンド>**

当ファンドは、日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果を目標としております。運用に際しては、アムンディ・日経225オープンマザーファンド受益証券を主要投資対象としております。当期においても、基本方針に基づきマザーファンドの組入比率は高位を維持しました。

<アムンディ・日経225オープンマザーファンド>

マザーファンドのポートフォリオにつきましては、アムンディ・日経225オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額の騰落率は+32.4%と、ベンチマーク（日経平均トータルリターン・インデックス）の騰落率（+33.5%）を1.1%下回る結果となりましたが、おおむねベンチマークと連動した動きとなりました。

マイナス要因：信託報酬などの費用負担

プラス要因：設定および解約に応じた先物売買時の約定価格と現物株価指数の差

【分配金】

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます（分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】**<当ファンド>**

引き続きアムンディ・日経225オープンマザーファンド受益証券の組入れを高位に維持することにより、日経平均トータルリターン・インデックスに連動した投資成果を目指して運用を行います。

<アムンディ・日経225オープンマザーファンド>

マザーファンドの今後の運用方針につきましては、アムンディ・日経225オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第25期 (2023年7月12日 ～2024年7月11日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	200円 (80) (94) (27)	0.825% (0.330) (0.385) (0.110)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	0 (0)	0.001 (0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (印 刷 費 用) (そ の 他)	4 (2) (1) (2)	0.018 (0.008) (0.003) (0.008)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	204	0.844	

期中の平均基準価額は24,295円です。

(注1) 費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

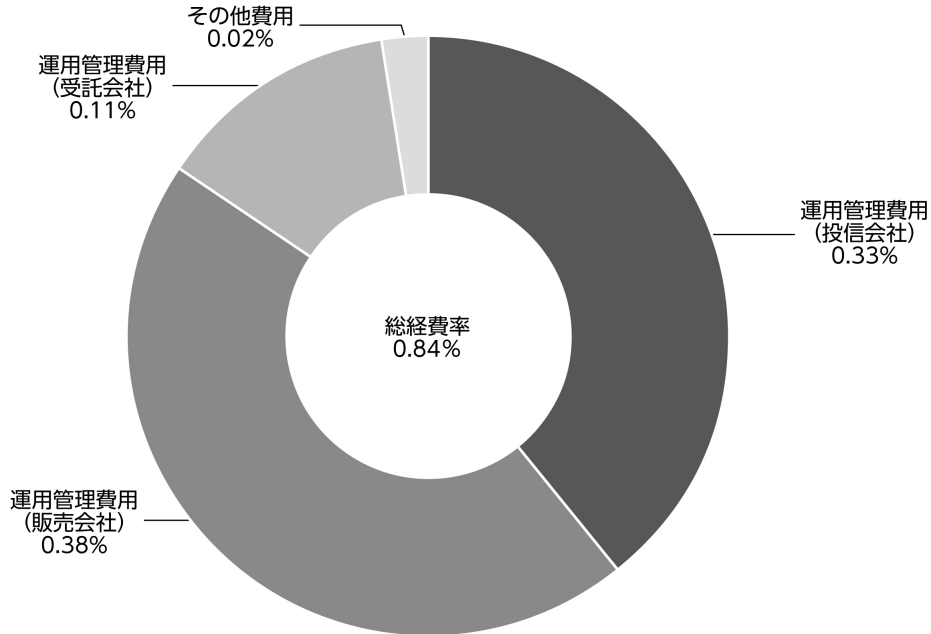
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

●総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.84%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応する費用を含みます。

(注5) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買及び取引の状況（2023年7月12日から2024年7月11日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
アムンディ・日経225オープンマザーファンド	766,009	2,176,900	1,867,559	5,531,715

(注) 単位未満は切捨てです。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	アムンディ・日経225オープンマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	10,266,403千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	38,723,290千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.26

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年7月12日から2024年7月11日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細（2024年7月11日現在）

親投資信託残高

銘 柄	期首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
アムンディ・日経225オープンマザーファンド	9,858,857	8,757,307	31,121,720

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) アムンディ・日経225オープンマザーファンド全体の受益権口数は、当期末12,602,708千口です。

■投資信託財産の構成 (2024年7月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
アムンディ・日経225オープンマザーファンド	31,121,720	99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	261,027	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	31,382,747	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年7月11日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	31,382,747,177円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	133,930,703
アムンディ・日経225オープンマザーファンド(評価額)	31,121,720,438
未 収 入 金	127,096,000
未 収 利 息	36
(B) 負 債	253,693,451
未 払 解 約 金	130,931,635
未 払 信 託 報 酬	119,241,290
そ の 他 未 払 費 用	3,520,526
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	31,129,053,726
元 本	10,777,283,170
次 期 繰 越 損 益 金	20,351,770,556
(D) 受 益 権 総 口 数	10,777,283,170口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,884円

(注記事項)

期首元本額	12,029,645,896円
期中追加設定元本額	1,806,479,954円
期中一部解約元本額	3,058,842,680円

■損益の状況

当期 (自2023年7月12日 至2024年7月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 32,148円
受 取 利 息	2,534
支 払 利 息	△ 34,682
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,553,486,201
売 買 益	8,237,929,111
売 買 損	△ 684,442,910
(C) 信 託 報 酬 等	△ 232,795,199
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	7,320,658,854
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,561,623,382
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,469,488,320
(配 当 等 相 当 額)	(10,281,396,972)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,811,908,652)
(G) 計 (D+E+F)	20,351,770,556
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	20,351,770,556
追 加 信 託 差 損 益 金	8,469,488,320
(配 当 等 相 当 額)	(10,286,528,335)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,817,040,015)
分 配 準 備 積 立 金	11,882,282,236

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

【分配原資の内訳】

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項 目	第25期
	(2023年7月12日～2024年7月11日)
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	20,569

(注1) 「対基準価額比率」は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

(注2) 「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

《お知らせ》

- ・2023年12月12日付で、ベンチマークを「日経平均株価」から「日経平均トータルリターン・インデックス」に変更するため、また、組入投資信託証券におけるデリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
- ・2024年3月9日付で、原則として1口単位で購入申込および解約申込ができることとするため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

アムンディ・日経225オープンマザーファンド

運用報告書

〈第25期〉

決算日：2024年7月11日

(計算期間：2023年7月12日～2024年7月11日)

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況についてご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	当ファンドは、日経平均トータルリターン・インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	東京証券取引所プライム市場に上場されている株式
組入制限	株式の投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均トータルリターン・インデックス (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	期中騰落率	騰落率	期中騰落率	騰落率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
21期 (2020年7月13日)	17,777	7.7	37,360.58	7.5	97.8	2.1	45,251
22期 (2021年7月12日)	22,641	27.4	47,599.55	27.4	97.5	2.4	43,935
23期 (2022年7月11日)	21,658	△ 4.3	45,555.95	△ 4.3	96.7	3.2	44,972
24期 (2023年7月11日)	26,615	22.9	55,957.81	22.8	97.6	2.4	36,995
25期 (2024年7月11日)	35,538	33.5	74,730.72	33.5	98.1	1.9	44,787

(注1) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。以下同じ。

(注2) ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。日経平均トータルリターン・インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均トータルリターン・インデックスを継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。またファンドの運用およびファンドの受益権の取引に関して、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

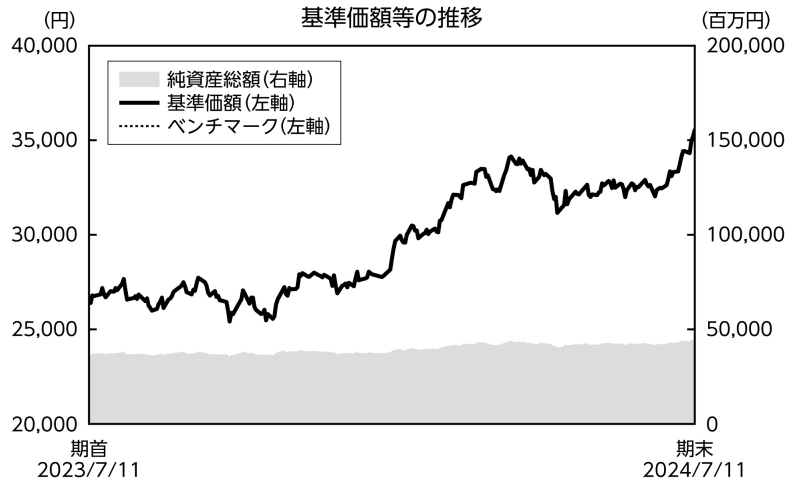
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		日経平均トータルリターン・インデックス (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%	円	%	%	%
2023年7月11日	26,615	—	55,957.81	—	97.6	2.4
7月末	27,418	3.0	57,645.38	3.0	98.1	1.9
8月末	26,975	1.4	56,720.29	1.4	97.2	2.8
9月末	26,530	△ 0.3	55,787.13	△ 0.3	96.3	3.5
10月末	25,698	△ 3.4	54,040.84	△ 3.4	96.0	4.0
11月末	27,890	4.8	58,651.09	4.8	97.1	2.8
12月末	27,915	4.9	58,704.41	4.9	99.0	1.0
2024年1月末	30,275	13.8	63,659.32	13.8	98.6	1.4
2月末	32,706	22.9	68,747.00	22.9	97.4	2.6
3月末	33,932	27.5	71,346.41	27.5	96.8	3.2
4月末	32,284	21.3	67,877.75	21.3	94.7	5.3
5月末	32,361	21.6	68,023.40	21.6	97.8	2.1
6月末	33,313	25.2	70,056.40	25.2	98.5	1.5
(期末)						
2024年7月11日	35,538	33.5	74,730.72	33.5	98.1	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第25期首	26,615円
第25期末	35,538円
騰落率	33.5%



(注1) ベンチマーク（ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数）は、日経平均トータルリターン・インデックスです。

(注2) ベンチマークは、2023年7月11日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 米国雇用統計の内容が弱かったことから利上げ観測が後退したこと（2023年11月）
- ② 東京証券取引所の要請に基づく企業のガバナンス改革への期待の高まりや、外国人投資家の買い、生成AI（人工知能）関連需要への期待が高まったこと（2024年1月～3月上旬）
- ③ 円安が進行したことで輸出関連企業の決算への期待が高まったこと（2024年6月～7月）

下落要因

- ① 中東情勢の緊迫化や米国で追加利上げに対する懸念が広がったこと（2023年9月～10月）
- ② 年度末を控えた機関投資家の利益確定売りに押されたことや、利下げ期待が後退し上値が重くなった米国株の影響を受けたこと（2024年3月下旬～4月）

【投資環境】**＜国内株式市場＞**

期初より2024年年初まで、国内株式市場は上下に触れながらもおおむね横ばいで推移しました。その後、中東情勢の緊迫化や米国で追加利上げに対する懸念が広がり米国長期金利も急騰したことから国内株式市場は値を下げました。11月には米国雇用統計の内容が弱かったために利上げ観測が後退したことを受けて、日本株は値がさ株を中心に堅調な地合いとなりました。年が明けると、東京証券取引所の要請に基づく企業のガバナンス改革への期待の高まり、外国人投資家の買い、生成A I（人工知能）関連需要に支えられた半導体関連株の力強い上昇がけん引し、国内株式市場は上昇しました。その後、日銀が金融政策決定会合でマイナス金利の解除やETF新規買入停止の政策変更を発表しましたが、影響は限定的で上昇を続けました。しかし、年度末を控えた機関投資家の利益確定売りに押され、また、利下げ期待が後退し上値が重くなった米国株の影響もあり、国内株式市場は下落に転じました。その後は円安が進むに連れ、輸出関連企業の業績改善に対する期待が高まり、日本株もじりじりと値を戻しました。

【ポートフォリオ】

当マザーファンドは、日経平均トータルリターン・インデックス採用銘柄のうち、流動性、財務内容等を勘案し、原則として200銘柄以上に投資を行い、日経平均トータルリターン・インデックスに連動した投資成果を目指します。

当期につきましては、引き続き225銘柄全てを組入れる完全法でポートフォリオを構築いたしました。期中の日経平均トータルリターン・インデックスの構成銘柄の変更に対しても適切に銘柄の入替えや組入比率の調整を行いました。期中の設定・解約に際しましては、株式先物を利用するとともに立会外取引、イブニング・セッションなどを利用しコストの削減と連動性の維持を図りました。株式組入比率は、期初より日経平均トータルリターン・インデックスとの連動性を維持するため、株式先物を利用することにより出来る限り高位を保ちました。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額の騰落率は+33.5%と、ベンチマーク（日経平均トータルリターン・インデックス）の騰落率（+33.5%）と同水準の結果となり、おおむねベンチマークと連動した動きとなりました。

プラス要因：設定および解約に応じた先物売買時の約定価格と現物株価指数の差

マイナス要因：売買手数料など

【今後の運用方針】

運用の基本方針に基づき、引き続き、日経平均トータルリターン・インデックスに連動した投資成果を目指して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第25期 (2023年7月12日 ～2024年7月11日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	0円 (0)	0.001% (0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.002	

期中の平均基準価額は29,774円です。

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況 (2023年7月12日から2024年7月11日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 645 (1,896)	千円 3,575,738 ()	千株 1,580	千円 6,690,665

(注1) 金額は受渡し代金です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(注3) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内 株 式 先 物 取 引	百万円 14,605	百万円 14,872	百万円 1,210	百万円 1,200

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	10,266,403千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	38,723,290千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.26

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■主要な売買銘柄 (2023年7月12日から2024年7月11日まで)

株 式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ディスコ	7	398,116	56,873	ファーストリテイリング	18	709,890	39,438
レーザーテック	15.6	370,596	23,756	東京エレクトロン	18	542,370	30,131
ニトリホールディングス	18.7	361,009	19,305	ソフトバンクグループ	36	285,246	7,923
ファーストリテイリング	6	225,240	37,540	アドバンテスト	48	272,096	5,668
東京エレクトロン	6	164,880	27,480	信越化学工業	30	171,690	5,723
ソシオネクスト	35	148,842	4,252	KDDI	36	164,634	4,573
ZOZO	35	132,731	3,792	ダイキン工業	6	135,425	22,570
メルカリ	39	124,197	3,184	TDK	18	134,769	7,487
ソフトバンクグループ	12	84,132	7,011	ファナック	30	125,170	4,172
アドバンテスト	16	74,400	4,650	テルモ	32	120,416	3,763

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 金額の単位未満は切捨てです。

■利害関係人との取引状況等 (2023年7月12日から2024年7月11日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細 (2024年7月11日現在)

(1) 国内株式

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)			
ニッスイ	38	34	28,828
鉱業(0.1%)			
INPEX	15.2	13.6	33,700
建設業(1.4%)			
コムシスホールディングス	38	34	110,296
大成建設	7.6	6.8	42,500
大林組	38	34	67,932
清水建設	38	34	31,766
長谷工コーポレーション	7.6	6.8	12,192
鹿島建設	19	17	48,560
大和ハウス工業	38	34	141,610
積水ハウス	38	34	125,086
日揮ホールディングス	38	34	43,146
食料品(2.9%)			
日清製粉グループ本社	38	34	62,594
明治ホールディングス	15.2	13.6	49,476
日本ハム	19	17	81,923
サッポロホールディングス	7.6	6.8	41,480
アサヒグループホールディングス	38	34	196,384
麒麟ホールディングス	38	34	73,423
宝ホールディングス	38	—	—
キッコーマン	38	170	335,750
味の素	38	34	210,018
ニチレイ	19	17	59,058
日本たばこ産業	38	34	150,926
繊維製品(0.1%)			
帝人	7.6	6.8	9,088
東レ	38	34	26,319
パルプ・紙(0.1%)			
王子ホールディングス	38	34	21,277
日本製紙	3.8	3.4	3,260
化学(6.4%)			
クラレ	38	34	64,260
旭化成	38	34	36,431
レゾナック・ホールディングス	3.8	3.4	13,158
住友化学	38	34	12,753
日産化学	38	34	171,360
東ソー	19	17	35,300
トクヤマ	7.6	6.8	20,495
デンカ	7.6	6.8	14,735
信越化学工業	190	170	1,141,550
三井化学	7.6	6.8	30,083
三菱ケミカルグループ	19	17	15,711
UBE	3.8	3.4	9,584

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
花王	38	34	230,248
D I C	3.8	3.4	10,285
富士フィルムホールディングス	38	102	398,718
資生堂	38	34	156,502
日東電工	38	34	461,550
医薬品(5.7%)			
協和キリン	38	34	105,434
武田薬品工業	38	34	146,608
アステラス製薬	190	170	282,540
住友ファーマ	38	34	13,872
塩野義製薬	38	34	227,460
中外製薬	114	102	648,108
エーザイ	38	34	235,484
第一三共	114	102	614,754
大塚ホールディングス	38	34	244,766
石油・石炭製品(0.2%)			
出光興産	15.2	68	69,938
ENEOSホールディングス	38	34	28,196
ゴム製品(0.6%)			
横浜ゴム	19	17	57,562
ブリヂストン	38	34	214,948
ガラス・土石製品(0.6%)			
A G C	7.6	6.8	36,040
日本板硝子	3.8	—	—
日本電気硝子	11.4	10.2	37,903
住友大阪セメント	3.8	—	—
太平洋セメント	3.8	3.4	13,838
東海カーボン	38	34	32,249
T O T O	19	17	69,020
日本碍子	38	34	72,284
鉄鋼(0.1%)			
日本製鉄	3.8	3.4	11,791
神戸製鋼所	3.8	3.4	6,764
J F Eホールディングス	3.8	3.4	7,993
大太平洋金属	3.8	—	—
非鉄金属(0.9%)			
三井金属鉱業	3.8	3.4	18,397
三菱マテリアル	3.8	3.4	10,363
住友金属鉱山	19	17	89,471
D O W Aホールディングス	7.6	6.8	39,807
古河電気工業	3.8	3.4	14,456
住友電気工業	38	34	85,816
フジクラ	38	34	115,498
金属製品(0.0%)			
S U M C O	3.8	3.4	8,987

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	7.6	6.8	30,178
オークマ	7.6	6.8	53,407
アマダ	38	34	63,359
ディスコ	—	6.8	466,072
SMC	3.8	3.4	280,704
小松製作所	38	34	164,424
住友重機械工業	7.6	6.8	28,689
日立建機	38	34	153,612
クボタ	38	34	75,599
荏原製作所	7.6	34	82,875
ダイキン工業	38	34	791,690
日本精工	38	34	27,886
NTN	38	34	11,386
ジェイテクト	38	34	38,845
三井E&S	3.8	—	—
日立造船	7.6	6.8	7,364
三菱重工業	3.8	34	62,373
IHI	3.8	3.4	18,717
電気機器 (28.0%)			
コニカミノルタ	38	34	15,847
ミネベアミツミ	38	34	121,992
日立製作所	7.6	34	128,486
三菱電機	38	34	96,543
富士電機	7.6	6.8	64,627
安川電機	38	34	191,522
ソシオネクスト	—	34	136,816
ニデック	30.4	27.2	191,678
オムロン	38	34	195,874
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.6	6.8	20,063
日本電気	3.8	3.4	46,308
富士通	3.8	34	90,695
ルネサスエレクトロニクス	38	34	114,988
セイコーエプソン	76	68	182,784
パナソニック ホールディングス	38	34	46,036
シャープ	38	34	33,170
ソニーグループ	38	34	522,920
TDK	114	102	1,120,470
アルプスアルパイン	38	34	54,451
横河電機	38	34	140,148
アドバンテスト	76	272	1,860,752
キーエンス	3.8	3.4	260,950
レーザーテック	—	13.6	465,256
カシオ計算機	38	34	41,582
ファナック	190	170	781,830
京セラ	76	272	540,056
太陽誘電	38	34	162,146
村田製作所	30.4	81.6	301,675

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
SCREENホールディングス	7.6	13.6	221,612
キヤノン	57	51	232,560
リコー	38	34	48,807
東京エレクトロン	114	102	3,881,100
輸送用機器 (4.4%)			
デンソー	38	136	352,716
川崎重工業	3.8	3.4	20,206
日産自動車	38	34	19,094
いすゞ自動車	19	17	37,697
トヨタ自動車	190	170	558,280
日野自動車	38	34	14,623
三菱自動車工業	3.8	3.4	1,734
マツダ	7.6	6.8	10,679
本田技研工業	76	204	351,594
スズキ	38	136	265,744
SUBARU	38	34	119,986
ヤマハ発動機	38	102	162,792
精密機器 (3.6%)			
テルモ	152	272	756,024
ニコン	38	34	58,072
オリンパス	152	136	366,996
HOYA	19	17	353,090
シチズン時計	38	34	37,162
その他製品 (2.1%)			
パンダイナムコホールディングス	114	102	328,236
TOPPANホールディングス	19	17	78,489
大日本印刷	19	17	93,670
ヤマハ	38	34	125,800
任天堂	38	34	309,400
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	3.8	3.4	2,820
中部電力	3.8	3.4	6,407
関西電力	3.8	3.4	9,072
東京瓦斯	7.6	6.8	23,358
大阪瓦斯	7.6	6.8	23,174
陸運業 (0.9%)			
東武鉄道	7.6	6.8	18,224
東急	19	17	29,495
小田急電鉄	19	17	26,469
京王電鉄	7.6	6.8	25,500
京成電鉄	19	17	88,995
東日本旅客鉄道	3.8	10.2	27,647
西日本旅客鉄道	3.8	6.8	19,934
東海旅客鉄道	3.8	17	59,959
ヤマトホールディングス	38	34	62,492
NIPPON EXPRESSホールディングス	3.8	3.4	25,044
海運業 (0.4%)			
日本郵船	11.4	10.2	48,776

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
商船三井	11.4	10.2	50,357
川崎汽船	11.4	30.6	76,285
空運業(0.2%)			
日本航空	38	34	87,601
ANAホールディングス	3.8	3.4	10,271
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
三菱倉庫	19	17	91,443
情報・通信業(11.1%)			
ネクソン	76	68	225,760
メルカリ	—	34	79,016
LINEヤフー	15.2	13.6	5,494
トレンドマイクロ	38	34	242,794
日本電信電話	380	340	54,230
KDDI	228	204	926,364
ソフトバンク	38	34	70,312
東宝	3.8	3.4	15,388
NTTデータグループ	190	170	404,940
コナミグループ	38	34	413,610
ソフトバンクグループ	228	204	2,431,680
卸売業(3.3%)			
双日	3.8	3.4	13,246
伊藤忠商事	38	34	275,400
丸紅	38	34	103,326
豊田通商	38	102	331,398
三井物産	38	68	256,020
住友商事	38	34	138,074
三菱商事	38	102	343,638
小売業(12.8%)			
J.フロントリテイリング	19	17	34,212
ZOZO	—	34	149,396
三越伊勢丹ホールディングス	38	34	123,216
セブン&アイ・ホールディングス	38	102	197,880
高島屋	19	17	52,071
丸井グループ	38	34	80,478
イオン	38	34	113,050
ニトリホールディングス	—	17	281,860
ファーストリテイリング	114	102	4,610,400
銀行業(0.7%)			
しずおかフィナンシャルグループ	38	34	50,677
コンコディア・フィナンシャルグループ	38	34	31,864
あおぞら銀行	3.8	3.4	8,493
三菱UFJフィナンシャル・グループ	38	34	60,928
りそなホールディングス	3.8	3.4	3,624
三井住友トラスト・ホールディングス	3.8	6.8	26,078
三井住友フィナンシャルグループ	3.8	3.4	37,621
千葉銀行	38	34	46,937
ふくおかフィナンシャルグループ	7.6	6.8	29,090
みずほフィナンシャルグループ	3.8	3.4	11,845

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
証券・商品先物取引業(0.2%)			
大和証券グループ本社	38	34	43,877
野村ホールディングス	38	34	32,816
松井証券	38	—	—
保険業(1.3%)			
SOMPOホールディングス	7.6	20.4	71,257
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	11.4	30.6	118,177
第一生命ホールディングス	3.8	3.4	16,099
東京海上ホールディングス	57	51	330,276
T&Dホールディングス	7.6	6.8	20,556
その他金融業(0.8%)			
クレディセゾン	38	34	115,124
オリックス	38	34	125,698
日本取引所グループ	38	34	132,804
不動産業(1.1%)			
東急不動産ホールディングス	38	34	36,805
三井不動産	38	102	152,286
三菱地所	38	34	88,842
東京建物	19	17	45,483
住友不動産	38	34	166,464
サービス業(4.2%)			
エムスリー	91.2	81.6	127,540
ディー・エヌ・エー	11.4	10.2	16,365
電通グループ	38	34	139,230
オリエンタルランド	38	34	155,584
サイバーエージェント	30.4	27.2	25,864
楽天グループ	38	34	30,926
リクルートホールディングス	114	102	962,982
日本郵政	38	34	56,729
セコム	38	34	326,502
合計	株数	金額	
	8,280	9,241	43,914,720
	銘柄数<比率>	225	225 <98.1%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨てです。ただし、評価額が単位未満の場合は小数で記載しています。

(注4) -印は組入れなしです。以下同じ。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄		当期末	
		買建額	売建額
国内	日経225	百万円 889	百万円 —
	日経225mini	—	21

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2024年7月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	43,914,720	97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,244,331	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	45,159,051	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年7月11日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	45,157,822,040円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,143,157,157
株 式(評価額)	43,914,720,960
未 収 入 金	32,779,149
未 収 配 当 金	40,633,250
未 収 利 息	313
差 入 委 託 証 拠 金	26,531,211
(B) 負 債	370,233,830
未 払 金	273,830
未 払 解 約 金	369,960,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	44,787,588,210
元 本	12,602,708,874
次 期 繰 越 損 益 金	32,184,879,336
(D) 受 益 権 総 口 数	12,602,708,874口
1万口当たり基準価額(C/D)	35.538円

(注記事項)

期首元本額	13,900,394,180円
期中追加設定元本額	1,676,521,105円
期中一部解約元本額	2,974,206,411円

(当期末元本の内訳)

りそな・日経225オープン	8,757,307,794円
アムンディ・日経225インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	661,692,965円
アムンディ・日経平均オープン	3,183,096,815円
りそな・日経225オープンVA (適格機関投資家専用)	611,300円

■損益の状況

当期 (自2023年7月12日 至2024年7月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	720,896,053円
受 取 配 当 金	718,581,390
受 取 利 息	24,537
そ の 他 収 益 金	2,751,571
支 払 利 息	△ 461,445
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,918,846,800
売 買 益	12,136,402,151
売 買 損	△ 1,217,555,351
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	255,730,941
取 引 益	399,744,817
取 引 損	△ 144,013,876
(D) そ の 他 費 用 等	△ 393,693
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	11,895,080,101
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	23,095,366,929
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,122,101,894
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 5,927,669,588
(I) 計 (E+F+G+H)	32,184,879,336
次 期 繰 越 損 益 金(I)	32,184,879,336

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

《お知らせ》

- ・2023年12月12日付で、ベンチマークを「日経平均株価」から「日経平均トータルリターン・インデックス」に変更するため、また、組入投資信託証券におけるデリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。